

Der ostdeutsche Arbeitsmarkt: Kann das ifo Beschäftigungsbarometer dessen konjunkturelle Dynamik abbilden?

Robert Lehmann*

Einleitung

Im Jahr 2005 sah sich der ostdeutsche Arbeitsmarkt einer Trendwende gegenüber. Erstmals seit Mitte der neunziger Jahre stieg die Zahl der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigten (SVB) wieder kontinuierlich an. Dieser Aufwärtstrend wurde lediglich durch die Wirtschafts- und Finanzkrise unterbrochen; dennoch präsentierte sich der Arbeitsmarkt, gestützt durch staatliche Interventionen, auch in dieser Phase als äußerst robust. Die Arbeitslosenquote (ALQ) in Ostdeutschland bewegt sich auf einem annähernd historisch niedrigen Niveau und betrug im Monat Oktober 2010 nur noch 11,9 % [vgl. BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT (2010a)].¹

Verschiedene Indikatoren wie die Anzahl der SVB, die ALQ oder die Zahl der Erwerbstätigen dienen vor allem als Gradmesser zur Beurteilung der aktuellen Arbeitsmarktlage. Dennoch weisen diese Statistiken zum Teil erhebliche Defizite auf [vgl. VOGT (2008); S. 41]. Im Rahmen der Beschäftigungsstatistik der BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT (BA) werden die Zahlen zur sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung erst mit mehrmonatiger Verzögerung veröffentlicht. Zudem handelt es sich bei den letzten vier Datenpunkten (aktuell die Monate April bis Juli 2010) um Hochrechnungen, die anschließend von der BA einer erheblichen Revision unterzogen werden. Da es aufgrund von Abgabefristen und Verzögerungen im Meldefluss zu Verzerrungen kommt, können die Ergebnisse der Beschäftigtenstatistik erst mit einem Nachlauf von sechs Monaten als endgültig bezeichnet werden [vgl. BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT (2010b); S. 5].

Da es aber insbesondere auf einen Indikator ankommt, der die konjunkturelle Arbeitsmarktdynamik einerseits zeitnah abbildet und andererseits keinen Revisionen unterliegt, soll in diesem Beitrag ein Beschäftigungsindikator für den ostdeutschen Arbeitsmarkt vorgestellt werden.

Die Niederlassung Dresden des IFO INSTITUTS FÜR WIRTSCHAFTSFORSCHUNG veröffentlicht schon seit geraumer Zeit ein Beschäftigungsbarometer für den Freistaat Sachsen, welches exklusiv für das SÄCHSISCHE STAATSMINISTERIUM FÜR WIRTSCHAFT, ARBEIT UND VERKEHR (SMWA) berechnet und monatlich im Wirtschaftstelegramm des SMWA veröffentlicht wird [vgl. SMWA (2010); S. 3]. Für

Ostdeutschland insgesamt liegt ein solcher Indikator bislang nicht vor. Diese Lücke wird durch nachfolgenden Beitrag geschlossen.

Datengrundlage

Die Grundlage zur Berechnung eines ostdeutschen Beschäftigungsindikators bilden die Umfrageergebnisse des monatlich vom ifo Institut durchgeführten Konjunkturtests. Dabei werden die gegenwärtig rund 1.200 teilnehmenden ostdeutschen Unternehmen aus der gewerblichen Wirtschaft² um Einschätzungen hinsichtlich unterschiedlicher Kriterien gebeten. Neben den beiden prominentesten Komponenten, der Geschäftslage und den Geschäftserwartungen, aus dem sich das bekannte ifo Geschäftsklima errechnet, wird auch nach der Entwicklung des zukünftigen Beschäftigungsbestandes gefragt. Dabei sollen die Unternehmen eine Einschätzung hinsichtlich ihrer Personalplanung für die kommenden drei Monate geben. Den Befragungsteilnehmern stehen drei verschiedene Antwortmöglichkeiten zur Verfügung: Die Anzahl der Beschäftigten kann entweder „zunehmen“, „abnehmen“ oder in „etwa gleichbleiben“ [vgl. RUPPERT (2004); S. 18].³ Anschließend werden die so genannten Beschäftigungserwartungen der einzelnen Bereiche der gewerblichen Wirtschaft gebildet. Dabei handelt es sich um mittels Unternehmensgrößenklassen gewichtete, saisonbereinigte Salden aus den Anteilen der Antworten „Zunahme“ und „Abnahme“ des Personalbestandes.

Für die Bereiche verarbeitendes Gewerbe, Bauhauptgewerbe sowie Groß- und Einzelhandel liegen dementsprechend monatliche Daten seit Januar 1993 vor. Um einen Indikator für die gewerbliche Wirtschaft Ostdeutschlands zu bilden, müssen zunächst geeignete Gewichte gefunden werden. Da es sich um eine Einschätzung hinsichtlich der Beschäftigungssituation handelt, sind Beschäftigungsanteile wohl der am besten geeignete Gewichtungsfaktor. Weiterhin müssen die Angaben

* Robert Lehmann ist Doktorand an der Niederlassung Dresden des ifo Instituts für Wirtschaftsforschung.

aus beiden Handelsabteilungen zu einem Indikator für den Handel insgesamt verdichtet werden. Dies geschieht mittels einer Gegenüberstellung der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigten im Groß- sowie Einzelhandel. Dabei ergibt sich in etwa ein Verhältnis von 1 : 2. Abschließend erfolgt erneut eine Gewichtung der Salden anhand der Beschäftigtenanteile der einzelnen Sektoren, sodass diese zur gewerblichen Wirtschaft insgesamt aggregiert werden können (verarbeitendes Gewerbe 43 %, Bau 25 %, Handel 32 %). Abschließend erfolgen eine analoge Transformation⁴ wie beim Geschäftsklimaindex sowie eine Normierung auf den Durchschnitt des Jahres 2000.

Um die Indikatoreigenschaften der Beschäftigungserwartungen zu überprüfen, wird zudem eine geeignete Referenzzeitreihe benötigt. Dazu stehen, wie eingangs erwähnt, drei potenzielle Größen zur Verfügung: die Arbeitslosenquote, die Zahl der Erwerbstätigen sowie die sozialversicherungspflichtige Beschäftigung. Bei der Arbeitslosenquote kam es in der Vergangenheit häufig zu methodischen sowie definitorischen Änderungen, was lange Vergleiche erheblich beeinträchtigen würde [vgl. HOTT und KUNKEL (2004); S. 53]. Außerdem bildet die Arbeitslosenquote Angebots- sowie nachfrageseitige Faktoren ab, währenddessen die Befragung im Konjunkturtest auf die Veränderung der Arbeitsnachfrage abzielt. Als zweite Referenzgröße würde die Zahl der Erwerbstätigen infrage kommen. Dies ist aber aus zwei Gründen ausgeschlossen. Zum einen liegen die Angaben der amtlichen Statistik für die Zahl der Erwerbstätigen in Ostdeutschland nicht in monatlicher Frequenz vor, sodass ein Vergleich mit den Ergebnissen des Konjunkturtests ohne weitere Transformation nicht möglich ist. Zum anderen zählen Beamte, Soldaten und Selbstständige definitorisch zu den erwerbstätigen Personen. Außerdem werden in der amtlichen Statistik Personen mit mehreren Beschäftigungsverhältnissen nur einmal erfasst [vgl. ABBERGER (2008); S. 20]. Demzufolge ergeben sich deutliche Unterschiede bei der Abgrenzung der Personen zwischen amtlicher Statistik und dem ifo Konjunkturtest.

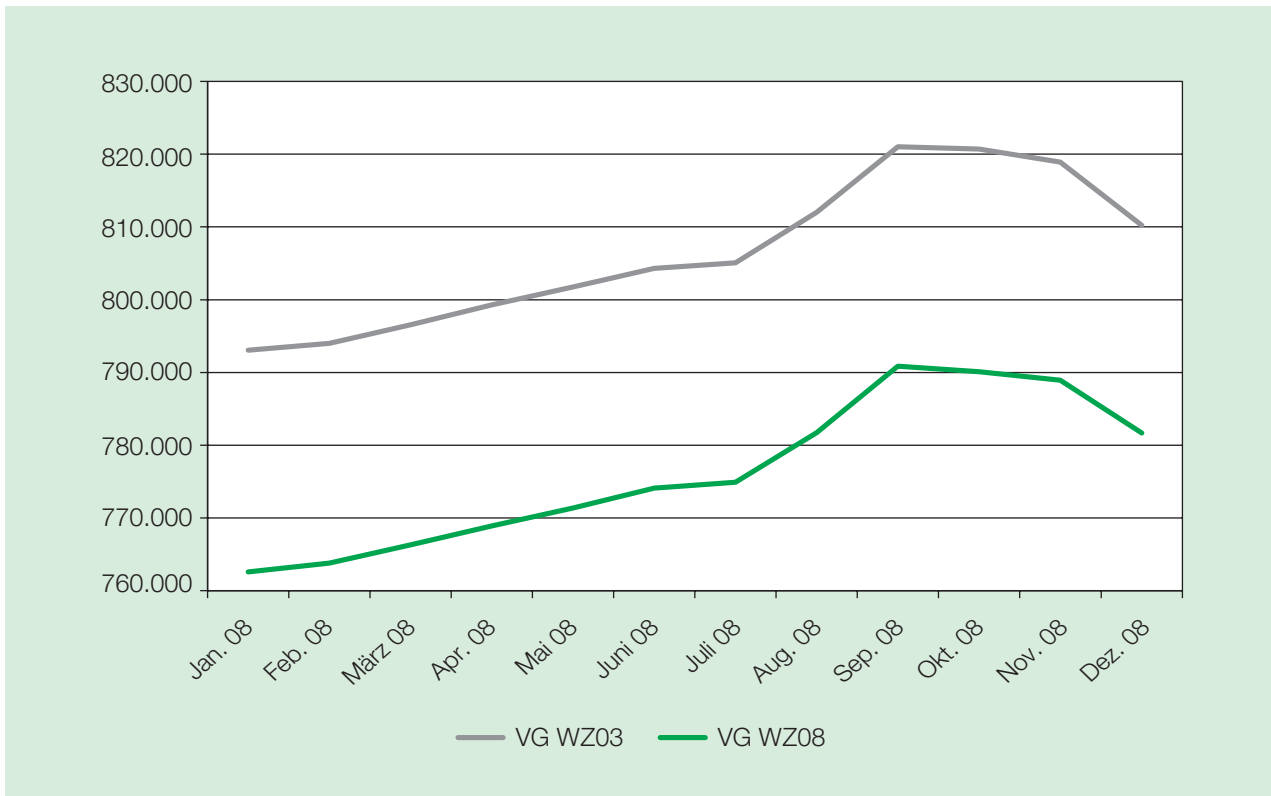
Da die sozialversicherungspflichtige Beschäftigung auf Monatsbasis erhoben wird und von ihrer Definition näher am Messkonzept⁵ des Konjunkturtestes liegt [vgl. ABBERGER (2008); S. 20], erfolgt nachfolgend die Betrachtung anhand dieser Statistik. Aktuell können für diese Untersuchung Zeitreihen zur sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung in den einzelnen Wirtschaftszweigen im Zeitraum Juni 1999 bis März 2010 verwendet werden. Diese bedürfen zunächst einer gesonderten Betrachtung, da zunächst verschiedene Transformationen notwendig sind, um eine weitere Analyse zu ermöglichen. Zum ersten ist das Anliegen des ifo Konjunkturtests eher

die Abbildung der konjunkturellen Grunddynamik des ostdeutschen Arbeitsmarktes, als eine Prognose der zahlenmäßigen Beschäftigung. Da zudem ein saisonales Muster in der Beschäftigungszeitreihe vorliegt, werden die Daten zur sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung in Wachstumsraten zum Vorjahr ausgewiesen⁶, um die Personalveränderungen adäquat darstellen zu können. Diese scheinen auf gesamtdeutscher Ebene eine geeignete Referenz für die Untersuchung zu sein [vgl. ABBERGER (2007); S. 251].⁷

Zweitens gab es in diesem Zeitraum eine Umstellung auf eine neue Wirtschaftszweigklassifikation (WZ). Dem muss in der Betrachtung gesondert Rechnung getragen werden. Nach der alten Klassifikation der WZ 2003 lagen die von der BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT ausgewiesenen Zeitreihen für den Zeitraum Juni 1999 bis Dezember 2008 vor. Für die neue Klassifikation der WZ 2008 sind die Zeitreihen für die Monate Januar 2008 bis März 2010 verfügbar. Da die alte WZ (WZ 2003) methodisch konsistent zur Befragung des IFO INSTITUTS ist, wird im Folgenden eine „hypothetische“ Zeitreihe für den Zeitraum ab Januar 2009 betrachtet. Diese wird erzeugt, indem die Wachstumsraten zum Vorjahresmonat der Zeitreihe nach WZ 2008 auf die alten Daten angewendet wird und somit eine Vorverkettung stattfindet. Dies hat den Vorteil, dass insofern keine strukturellen Brüche in der Zeitreihe erzeugt werden. Nachteilig daran ist, dass implizit ein äquivalentes Wachstum der jeweiligen Unterbereiche unterstellt wird. Man stelle sich vor, dass der Unterbereich X des verarbeitenden Gewerbes einen exogenen Schock erleidet und der gesamte Beschäftigungsrückgang explizit durch diesen Bereich initiiert wird. Wenn dieser Unterbereich X nach Umstellung der Systematik der Wirtschaftszweige nun nicht mehr im verarbeitenden Gewerbe enthalten ist, so würde ein „falsches“ Wachstum unterstellt werden, welches in dieser Form, nach Umstellung, gar nicht zustande gekommen wäre. Da es aber leider keine längeren, überlappenden Zeitreihen gibt, kann der gleiche Verlauf entweder annahmegemäß unterstellt werden oder die Wachstumsraten zeigen einen ähnlichen Charakter und unterscheiden sich einzig und allein durch einen Niveaueffekt. Exemplarisch soll an dieser Stelle das Verlaufsbild im verarbeitenden Gewerbe dargestellt werden. Abbildung 1 zeigt die Zahl der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigten nach alter (WZ 2003) und neuer (WZ 2008) Systematik.

Hierin zeigt sich ganz eindeutig, dass die Verlaufsbilder ähnlichen Charakter aufweisen.⁸ Lediglich der Niveaueffekt ist erkennbar. Es ist natürlich denkbar, dass dieses Phänomen insbesondere der Umstellung und damit der Erfassung geschuldet ist. Dies kann aber nicht abschließend geklärt werden, sodass die Vorverkettung im Folgenden als adäquat betrachtet wird.

Abbildung 1: Entwicklung der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung im verarbeitenden Gewerbe nach neuer und alter Wirtschaftszweigklassifikation



Quelle: Bundesagentur für Arbeit.

Drittens bezieht sich die Betrachtung auf Ostdeutschland ohne Berlin, da dies konsistenter zur Befragung im ifo Konjunkturtest ist.

Indikatoreigenschaften

In einem ersten Schritt sollen die bereits für Deutschland bzw. Sachsen gefundenen Eigenschaften der jeweiligen Indikatoren kurz beleuchtet werden. Danach erfolgt eine graphische Analyse für den ostdeutschen Arbeitsmarkt, die abschließend durch eine Korrelationsanalyse konkretisiert wird.

Das gesamtdeutsche Beschäftigungsbarometer wird vom IFO INSTITUT exklusiv für die FINANCIAL TIMES DEUTSCHLAND berechnet und auf der Internetpräsenz des IFO INSTITUTS veröffentlicht. In einer wissenschaftlichen Untersuchung von ABERGER (2007) wurden die Vorlaufeigenschaften dieses Indikators einer näheren Betrachtung unterzogen. Dabei stellte sich heraus, dass die Beschäftigungserwartungen einen sehr nützlichen Beitrag zur Erklärung der gesamtdeutschen Arbeitsmarktdynamik leisten. Insbesondere konnte ein Vorlauf von zwei bis vier Monaten festgestellt werden. VOGT (2008) konnte für die sächsische Zeitreihe hohe Korrelationskoeffizienten

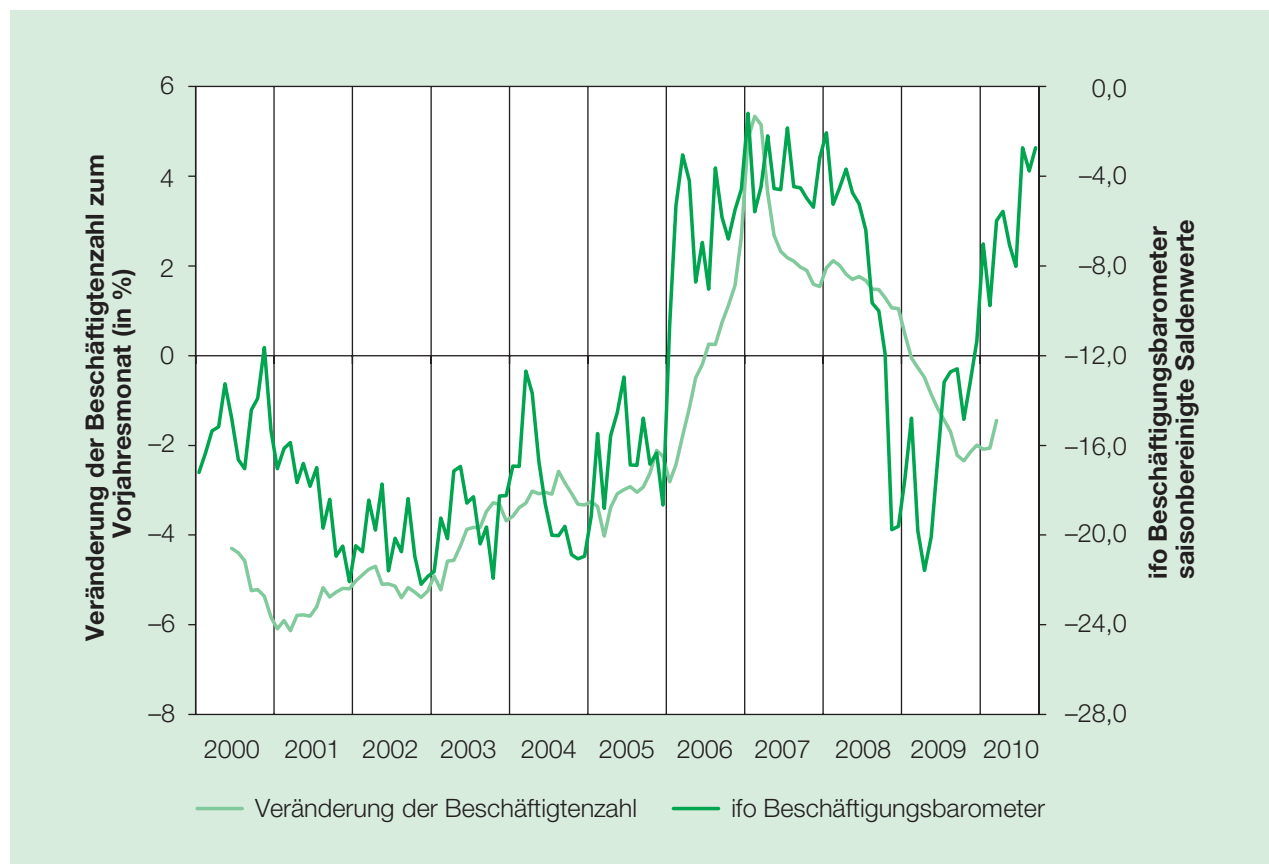
bis zu einer Verzögerung von sechs Monaten ermitteln, sodass der Indikator vor allem am „aktuellen Rand“ wichtige Aussagen über die Dynamik des Arbeitsmarkts treffen kann und zudem für Prognosezwecke einsetzbar ist. Nun stellt sich unmittelbar die Frage: Wie gestaltet sich dies für den ostdeutschen Arbeitsmarkt?

Das Beschäftigungsbarometer für die ostdeutsche gewerbliche Wirtschaft bietet zunächst zwei essenzielle Vorteile gegenüber der amtlichen Statistik. Zum einen liegen die Informationen zeitnah am Ende eines Monats vor, wodurch ein Informationsvorsprung besteht. Zum anderen unterliegen die Ergebnisse des ifo Konjunkturtests nur marginalen Revisionen aufgrund von neuen Beobachtungspunkten im Rahmen der Saisonbereinigung.⁹

Eine graphische Gegenüberstellung beider Zeitreihen soll zunächst einen ersten optischen Zusammenhang beider Zeitreihen liefern. In Abbildung 2 sind die prozentualen Veränderungsrate der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung zum Vorjahresmonat den saisonbereinigten Saldenwerten der Beschäftigungserwartungen des ifo Konjunkturtests der gewerblichen Wirtschaft Ostdeutschlands gegenübergestellt.

Die Beschäftigungssituation war insbesondere in den Jahren 2000 bis 2005 alarmierend, da es in diesem Zeitraum zu einer deutlichen Verringerung der Beschäftigung

Abbildung 2: Vergleich von ifo Beschäftigungsbarometer und Veränderungen der Beschäftigtenzahl für die gewerbliche Wirtschaft Ostdeutschlands



Quellen: Bundesagentur für Arbeit, ifo Konjunkturtest, Berechnungen des ifo Instituts.

kam. Allerdings gibt es seit Mitte des Jahres 2006 einen Anstieg der Beschäftigung im Vergleich zum Vorjahr. Diese beobachtbare Zunahme wurde indes durch die Wirtschafts- und Finanzkrise wieder gebremst, sodass sich bis Mitte des Jahres 2010 erneut rückläufige Beschäftigtenzahlen einstellten.

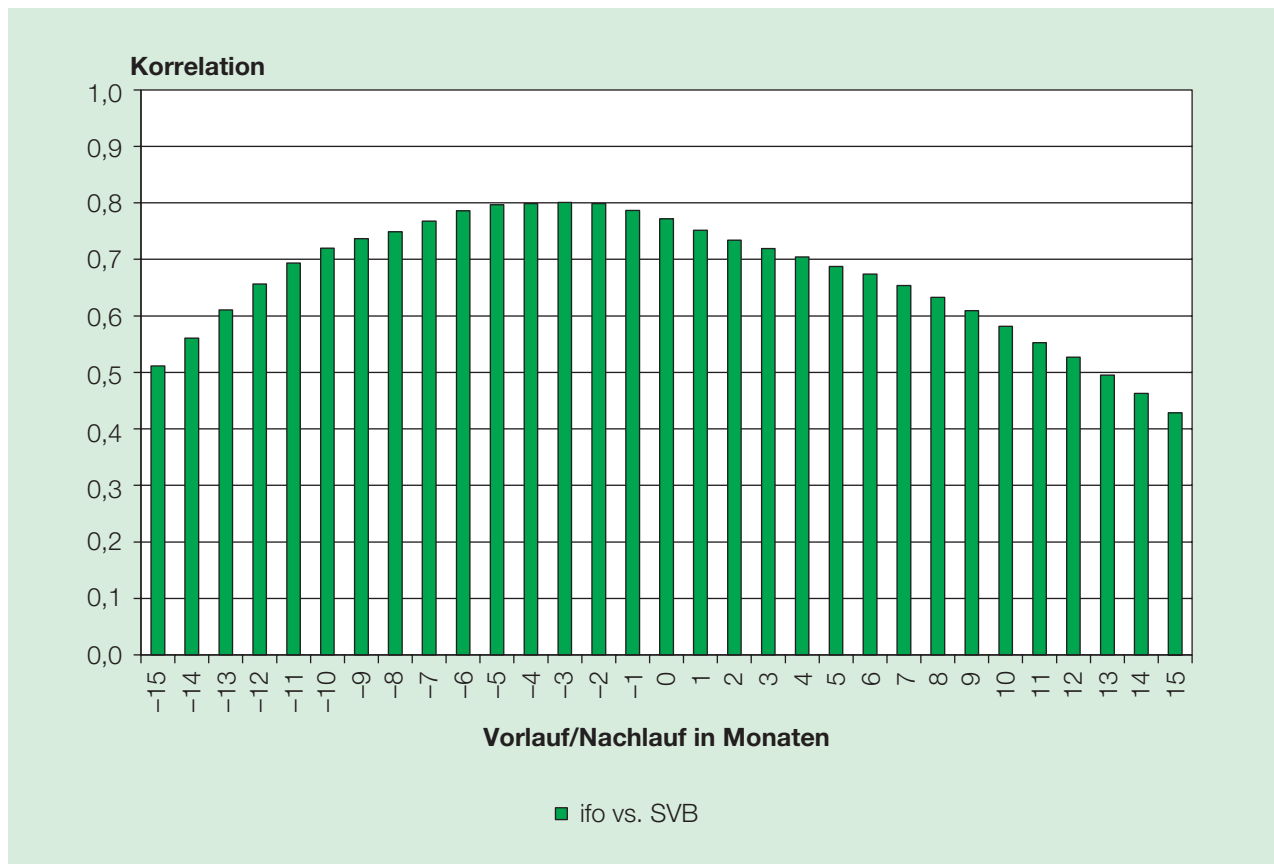
Der Vergleich zu den ifo Beschäftigungserwartungen zeigt in den Jahren 2000 bis 2002 zunächst keinen eindeutigen Zusammenhang mit der Entwicklung der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung. Erst mit dem Jahr 2003 offenbaren sich gewisse Vorlaufeigenschaften des Indikators. Die Beschäftigungserwartungen hellen sich analog der Beschäftigungssituation auf und zeigen Wendepunkte frühzeitig an. Eine deutliche Aufhellung der Beschäftigungspläne ist zu Beginn des Jahres 2006 erkennbar. Dies vollzieht sich auch wenig später in der Anzahl der Beschäftigtenverhältnisse. Auch über das Jahr 2007 hinweg bleiben die Beschäftigungserwartungen auf einem hohen Niveau. Erst mit Einsetzen der ersten Verwerfungen im Vorfeld der Wirtschafts- und Finanzkrise trüben sich Beschäftigtenenerwartungen wieder ein und fallen im Verlauf des Jahres 2008 auf ein deutlich niedrigeres Niveau zurück. Der Tiefpunkt der Beschäftigung

am Ende des Jahres 2009 wird vom untersuchten Indikator frühzeitig angezeigt; zudem ist dieser seit geraumer Zeit wieder deutlich nach oben gerichtet.

Zunächst kann konstatiert werden, dass das ifo Beschäftigungsbarometer die Dynamik am ostdeutschen Arbeitsmarkt sehr gut abbilden kann. Zudem zeigt sich offensichtlich ein Vorlauf der ifo Zeitreihe gegenüber der Veränderung der Beschäftigtenverhältnisse. Dieser letzte Punkt soll abschließend mittels einer Korrelationsanalyse überprüft werden.

Um den durchschnittlichen linearen Zusammenhang zwischen beiden Zeitreihen festzustellen, wird sich im Folgenden der Kreuzkorrelationen bedient. Die Korrelation ist definitionsgemäß ein Maß zwischen 1 und -1, wobei sich die Extremwerte bei perfektem positiven bzw. negativen linearen Zusammenhang ergeben. Eine Kreuzkorrelation lässt sich ermitteln, indem man beide Zeitreihen zeitlich zueinander verschiebt. Dabei lassen sich Vor- (Lead) bzw. Nachläufe (Lag) erkennen. In Abbildung 3 ist das Kreuzkorrelogramm zwischen den Beschäftigungserwartungen und der Veränderung der Beschäftigtenzahl bei verschiedenen Vor- bzw. Nachläufen abgebildet.

Abbildung 3: Kreuzkorrelationen zwischen dem ifo Beschäftigungsbarometer und der Veränderung der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung



Quelle: Berechnungen und Darstellung des ifo Instituts.

Der zuvor skizzierte graphische Eindruck wird durch das Kreuzkorrelogramm eindeutig unterstützt. Die höchste Korrelation (0,8006) zwischen beiden Zeitreihen ist bei einem Vorlauf der ifo Beschäftigungserwartungen von drei Monaten beobachtbar. Unmittelbar benachbarte Werte neben der maximalen Korrelation weisen immer noch sehr hohe Werte auf. Außerdem bleibt der zeitliche Vorlauf auch recht stabil, da auch bei einer Verzögerung von 12 Monaten im Durchschnitt noch eine sehr hohe Korrelation (0,6568) beobachtbar ist. Zudem ist bemerkenswert, dass die lineare Beziehung zwischen beiden Reihen deutlich weniger stark ausfällt, wenn die Beschäftigungserwartungen zeitlich nach vorn verschoben werden, also einen Lag aufweisen.

Nach dieser Betrachtung kann offensichtlich festgehalten werden, dass das ifo Beschäftigungsbarometer für die gewerbliche Wirtschaft Ostdeutschlands ein zuverlässiger Indikator ist zur Beurteilung der Arbeitsmarktdynamik in den neuen Bundesländern. Dabei besteht über den gesamten Betrachtungszeitraum hinweg eine enge positive Beziehung zwischen beiden Zeitreihen, sodass tendenziell von einem vorlaufenden Indikator gesprochen werden kann.

Fazit

Das IFO INSTITUT veröffentlicht monatlich einen Beschäftigungsindikator zum einen für Deutschland insgesamt und zum anderen für den Freistaat Sachsen. Auffällig ist, dass bisher kein solcher Indikator für Ostdeutschland vorliegt. Dieser Artikel stellt einen solchen vor und untersucht, ob dieser die konjunkturelle Grunddynamik des ostdeutschen Arbeitsmarktes abzubilden vermag. Dabei zeigt sich, dass die ifo Beschäftigungserwartungen für die gewerbliche Wirtschaft Ostdeutschlands ein dafür geeignetes Instrument darstellen. Zudem zeichnen sich die Befragungsdaten des IFO INSTITUTS durch eine zeitnahe Veröffentlichung und sehr geringe Revisionen aus. Demnach besitzt das ifo Beschäftigungsbarometer Ostdeutschlands nicht nur einen Vorlauf im statistischen Sinne, sondern auch einen Informationsvorsprung vor den Daten der amtlichen Statistik und kann sowohl für die Beurteilung der Arbeitsmarktsituation am aktuellen Rand sowie für Prognosezwecke eingesetzt werden. Aktuell befindet sich das ifo Beschäftigungsbarometer auf einem sehr hohen Niveau, sodass mit einer weiteren Entspannung auf dem ostdeutschen Arbeitsmarkt gerechnet werden kann.

Literatur

- ABBERGER, K. (2007): Qualitative business surveys and the assessment of employment – A case study for Germany. In: International Journal of Forecasting Vol. 23, S. 249–258.
- ABBERGER, K. (2008): Das ifo Beschäftigungsbarometer: Ein Druckmesser für den deutschen Arbeitsmarkt. In: ifo Schnelldienst 9/2008, 61. Jahrgang, S. 19–22.
- BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT (Hrsg.) (2010a): Arbeitsmarkt in Zahlen, Arbeitslosigkeit im Zeitverlauf Oktober 2010.
- BUNDESAGENTUR FÜR ARBEIT (Hrsg.) (2010b): Arbeitsmarkt in Zahlen, Beschäftigung nach Ländern in wirtschaftsfachlicher Gliederung (WZ 2008).
- HOTT, C. und KUNKEL, A. (2004): Ein ifo Beschäftigungsindikator. In: ifo Schnelldienst 6/2004, 57. Jahrgang, S. 53–57.
- RUPPERT, W. (2004): Konjunkturtest Verarbeitendes Gewerbe. In: ifo Beiträge zur Wirtschaftsforschung Nr. 15, S. 16–28.
- STAATSMINISTERIUM FÜR WIRTSCHAFT, ARBEIT UND VERKEHR (SMWA) (Hrsg.) (2010): Wirtschaftstelegramm für den Freistaat Sachsen September 2010.
- VOGT, G. (2008): Ein Beschäftigungsbarometer für die sächsische Wirtschaft. In: ifo Dresden berichtet 1/2008, 15. Jahrgang, S. 41–43.

- ¹ Bei der hier angegebenen Arbeitslosenquote handelt es sich um die Betrachtung der Arbeitslosen in Bezug auf die abhängigen zivilen Erwerbspersonen.
- ² Darunter zählen Firmen aus den Bereichen verarbeitendes Gewerbe, Bauhauptgewerbe sowie aus den beiden Handelsabteilungen Groß- und Einzelhandel.
- ³ Hier wurde nur der Fragebogen des verarbeitenden Gewerbes zitiert. In der angegebenen Quelle finden sich aber auch die Fragebögen zum Bauhauptgewerbe sowie zum Handel. Diese sind äquivalent aufgebaut und demzufolge miteinander vergleich- bzw. aggregierbar.
- ⁴ Zunächst erfolgt eine Erhöhung der Saldenwerte um den Faktor 200. Abschließend werden alle transformierten Werte auf das jahresdurchschnittliche Niveau des Jahres 2000 normiert, um die längerfristige Vergleichbarkeit zu gewährleisten.
- ⁵ An dieser Stelle sei erwähnt, dass es sich beim Konjunkturtest um eine Befragung zur gesamten Personalplanung handelt, die nicht zwischen Voll- oder Teilzeitbeschäftigten bzw. geringfügig beschäftigten Personen unterscheidet.
- ⁶ HOTT und KUNKEL (2004) merken an, dass möglicherweise die Transformation in Veränderungsraten zum Vorjahr potenzielle Vorlaufeigenschaften des ifo-Indikators eliminieren.
- ⁷ Eine Spektral- und Kohärenzanalyse auf gesamtdeutscher Ebene ergab, dass der Zusammenhang mit Wachstumsraten zum Vorjahresmonat deutlich stärker ist, als jener mit 3-Monatsveränderungsraten [vgl. ABBERGER (2007); S. 251].
- ⁸ An dieser Stelle sei angemerkt, dass die Verlaufsbilder im Bereich Bauhauptgewerbe sowie dem Handel insgesamt ebenfalls ähnlichen Charakter aufweisen. Demzufolge erfolgt die Betrachtung der gewerblichen Wirtschaft anhand dieser „hypothetischen“ Zeitreihe.
- ⁹ Natürlich ist auch hier denkbar, dass es in den nächsten Jahren aufgrund methodischer Änderungen zu stärkeren Revisionen kommen kann.